

FX / 임지훈

☎ 82-2-3774-0423

✉ jihunlim@futures.co.kr

◇ 전일 국내시장 동향

종목	전일종가	전일비 (원)	변동폭 (고가-저가)	미결제약정 (계약)
USD010	1147.20	▲0.1	4.6	647,508
USD011	1147.20	▼0.3	4.6	138,934
USD/KRW	1147.10	▲0.3	4.3	
USD/CNY	6.7464	▼0.0029	0.0083	

◇ 전일 해외시장 동향

종목	전일종가	전일비(bp)	종목	전일종가
USD Index	93.526	▲0.4610	UST2Y	0.1390
EUR/USD	1.1746	▼0.0067	UST10Y	0.7272
USD/JPY	105.48	▲0.1500	UST30Y	1.5107
GBP/USD	1.2937	▼0.0127	WTI	40.18

차트1. 달러/원 & 달러/위안



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트2. 달러/원 & 달러/인덱스



출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 경제지표 및 이벤트

전 일(10/13)

- 18:00 독일 10월 ZEW 서베이(결과:56.1, 이전:77.4)
- 19:00 미국 9월 NFIB 소기업 낙관지수(결과:104.0, 이전:100.2)
- 21:30 미국 9월 CPI YoY(결과:-1.4%, 이전:-1.3%)

금 일(10/14)

- 08:30 호주 10월 웨스트팩 소비자기대지수(예상:--, 이전:93.8)
- 13:30 일본 8월 산업생산 MoM(F)(예상:--, 이전:9.6%)
- 20:00 미국 MBA 주택융자 신청지수(예상:--, 이전:4.6%)
- 21:30 미국 9월 PPI YoY(예상:0.2%, 이전:-0.2%)
- 22:00 미국 Fed 리처드 클라리디 부의장 연설
- 23:30 미국 Fed 웬들 콜스 부의장 연설
- N/A 한국은행 10월 금통위 기준금리 결정(예상:기준금리 동결)

의 일(10/15)

- 10:30 중국 9월 PPI YoY(예상:-1.8%, 이전:-2.0%)
- 10:30 중국 9월 CPI YoY(예상:1.9%, 이전:2.4%)
- 21:30 미국 10월 엠파이어스테йт 제조업지수(예상:14.0, 이전:17.0)
- 21:30 미국 주간 신규 실업수당 청구건수(예상:825k, 이전:840k)
- 21:30 미국 9월 수입물가지수 MoM(예상:0.2%, 이전:0.9%)
- 21:30 미국 10월 필라델피아 연은 경기전망(예상:14.3, 이전:15.0)
- 00:00 미국 DOE 주간 원유재고(예상:--, 이전:501k)

USD Futures & Spot

종목	종가	전일비	시가	고가	저가	변동폭	거래량	전일대비	미결제약정	전일대비
USD010	1,147.20	0.10	1,149.00	1,151.60	1,147.00	4.60	292,386	4,714	647,508	-82,943
USD011	1,147.20	-0.30	1,149.00	1,151.50	1,146.90	4.60	31,150	18,145	138,934	111,063
USD SPOT	1,147.10	0.30	1,148.30	1,151.40	1,147.10	4.30	7,179	1,276	-	-

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

USD Futures 전일 투자자별 매매동향

구분	매수	매도	순매수	5일누적	20일누적
금융투자	159,146	134,433	24,713	-16,247	-30,717
은행	72,307	72,783	-476	-16,252	3,059
투신	43,373	44,612	-1,239	-9,229	-28,615
보험	43,578	44,244	-666	-3,968	-2,412
기타법인	18,531	16,452	2,079	12,943	39,825
개인	29,548	37,715	-8,167	-3,374	17,431
외국인	169,642	185,886	-16,244	36,227	1,429

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

국내 시장 동향

종목	주가/금리	전일비
KOSPI	2,403.15	-0.58
국고채3Y	0.923	-0.002
국고채10Y	1.527	-0.026

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

신용지표

만기	Mid	전일비
CDS 5Y	24.098	-0.109

출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

외국인 증권투자동향

종목	순매수	5일 누적	20일누적
KOSPI	2,137	11,905	16,298
KOSDAQ	-614	-953	-2,807
국고채	25	-332	33,770
통안채	3,296	15,356	34,483

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

Korea - US 금리

Korea	종가	전일비	US Libor	종가	전일비
기준	0.500	0.000	1M	0.14838	0.00413
Call	0.600	0.000	3M	0.23688	0.00800
CD	0.630	0.000	6M	0.25450	0.01162
통안1년	0.701	-0.001	12M	0.34550	-0.00213

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

글로벌 금융시장

종목	종가	전일비	전일비(%)	1주(%)
다우지수	28,679.81	-157.71	-0.55	3.27
S&P	3,511.93	-22.29	-0.63	4.49
나스닥	11,863.90	-12.36	-0.10	6.36
FTSE 100	5,969.71	-31.67	-0.53	0.33
DAX 30	13,018.99	-119.42	-0.91	0.88
Nikkei 225	23,601.78	43.09	0.18	0.72
Shanghai	3,359.75	1.28	0.04	4.42
항셍 H	9,878.74	260.89	2.71	4.56
미국채 2년	0.14	-0.01	-9.09	-5.25
미국채 10년	0.73	-0.05	-6.01	-1.10
WTI	40.18	0.75	1.90	-1.20
Gold	1,891.41	-33.53	-1.74	-0.66

출처 : 인포맥스, Bloomberg, NH선물 리서치센터

FX Swap points

만기	Mid	전일비
1M	0.15	0.05
3M	-0.10	0.05
6M	-0.40	0.10
12M	-1.60	0.20

출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

CRS

만기	Mid	전일비
1Y	0.120	0.015
2Y	0.080	0.015
3Y	0.105	0.020
4Y	0.130	0.020
5Y	0.210	0.020

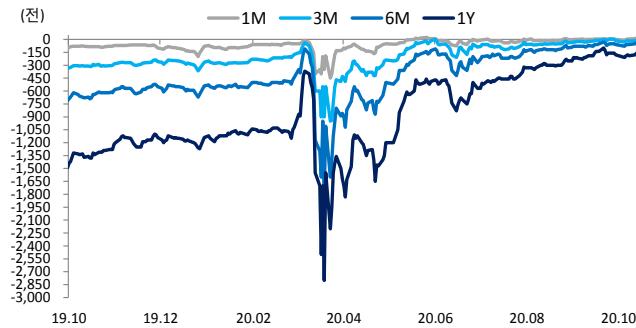
출처 : 인포맥스, NH선물 리서치센터

주요 통화 *영업일 기준으로 집계

아시아 통화					기타 통화						
종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)	종목	종가	전일비	1주(%)
USD Index	93.526	0.461	-0.17	USD/KRW	1,147.10	0.10	-1.20	USD/RUB	77.0417	-0.0883	-1.78
EUR/USD	1.1746	-0.0067	0.10	USD/CNY	6.7466	0.0007	-1.02	USD/BRL	5.5709	-0.0407	-0.41
USD/JPY	105.48	0.15	-0.14	USD/HKD	7.7501	0.0001	0.00	USD/ZAR	16.4731	-0.0386	-1.55
GBP/USD	1.2937	-0.0127	0.43	USD/SGD	1.3602	0.0030	-0.20	USD/MXN	21.3447	0.1414	-1.76
USD/CHF	0.9150	0.0059	-0.33	USD/TWD	28.789	0.033	-0.99	USD/PLN	3.8264	0.0506	0.11
AUD/USD	0.7161	-0.0048	0.83	USD/INR	73.36	0.08	-0.14	USD/TRY	7.9182	0.0225	1.53
NZD/USD	0.6651	0.0004	0.97	USD/IDR	14,725	25	-0.07	USD/SEK	8.8309	0.0214	-1.45
USD/CAD	1.3139	0.0025	-1.30	USD/THB	31.185	0.115	-0.02	USD/NOK	9.2370	0.0994	-1.35

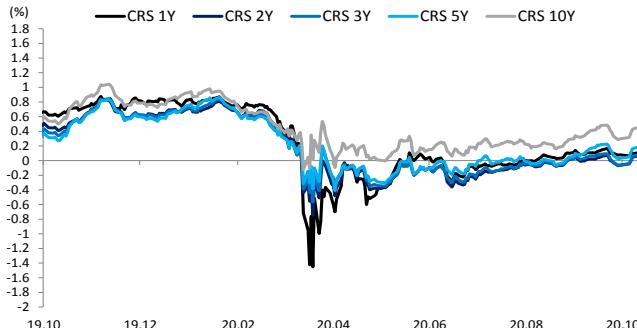
출처 : Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. FX Swap Point



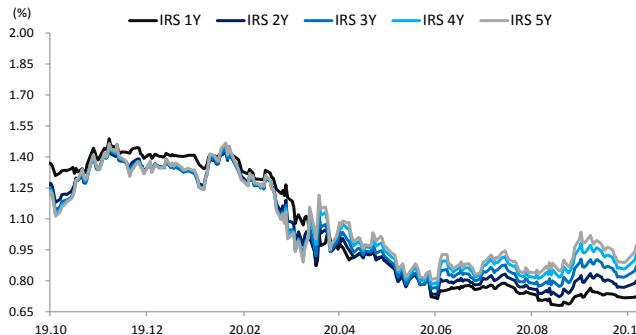
출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. IRS



출처: 인포맥스, NH선물 리서치센터

차트. CDS Premium 5Y



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 달러/위안



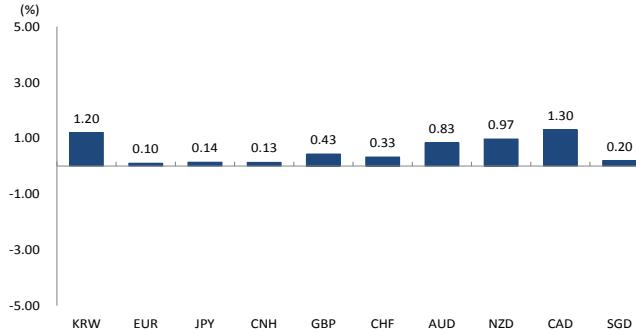
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 신흥국 주가지수 & 통화 지수



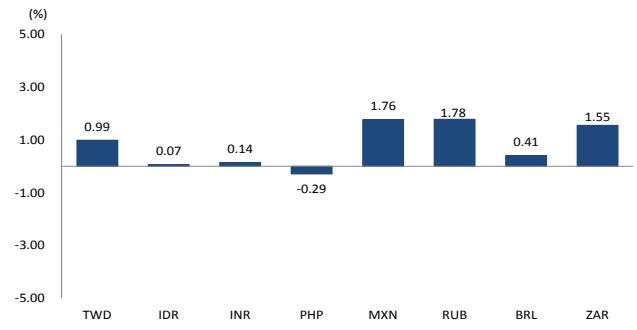
출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 주요통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터

차트. 주간 신흥국, 아시아 통화 달러대비 절상(절하)율



출처: Bloomberg, NH선물 리서치센터